

鹏华全球中短债债券型证券投资基金 (QDII) (原鹏华环球发现证券投资基金) 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本基金系原鹏华环球发现证券投资基金转型而来。鹏华环球发现证券投资基金基金份额持有人大会于2019年12月26日表决通过了《关于鹏华环球发现证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，鹏华基金管理有限公司决定对鹏华环球发现证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，转型为鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII），基金份额折算基准日为2020年1月7日。根据《关于鹏华环球发现证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华环球发现证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》、《鹏华环球发现证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）基金合同》、《鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）托管协议》，并据此编制《鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）招募说明书》。鹏华环球发现证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华环球发现证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2019]2231号）准予变更注册。《鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）基金合同》、《鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）托管协议》将自鹏华环球发现证券投资基金基金份额折算基准日的次一工作日起，即2020年1月8日起生效。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原鹏华环球发现证券投资基金报告期自2020年1月1日至2020年1月7日止，鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）报告期自2020年01月08日（基金合同生效日）起至2020年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型后）	8
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型前）	9
2.5 信息披露方式	9
2.6 其他相关资料（转型后）	9
2.6 其他相关资料（转型前）	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）	10
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）	11
3.2 基金净值表现（转型后）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	13
3.3 其他指标	14
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	16
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	17
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	19
6.1 资产负债表	19

6.2 利润表	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	49
6.1 资产负债表	49
6.2 利润表	50
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	51
6.4 报表附注	53
§7 投资组合报告（转型后）	73
7.1 期末基金资产组合情况	73
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	73
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	74
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	74
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	75
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	78
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	78
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	79
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	79
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	79
7.11 投资组合报告附注	79
§7 投资组合报告（转型前）	80
7.1 期末基金资产组合情况	80
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	81
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	81
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	81
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	82
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	83
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	83
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	83
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	83
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	83
7.11 投资组合报告附注	84
§8 基金份额持有人信息（转型后）	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	85
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	86
§8 基金份额持有人信息（转型前）	86
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	86

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	86
§9 开放式基金份额变动（转型后）	86
§9 开放式基金份额变动（转型前）	87
§10 重大事件揭示.....	87
10.1 基金份额持有人大会决议	87
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	87
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	87
10.4 基金投资策略的改变	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	87
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	87
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	91
10.8 其他重大事件（转型后）	95
10.9 其他重大事件（转型前）	99
§11 影响投资者决策的其他重要信息	100
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	100
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
§12 备查文件目录.....	100
12.1 备查文件目录	100
12.2 存放地点	101
12.3 查阅方式	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	鹏华全球中短债债券型证券投资基金 (QDII)	
基金简称	鹏华全球中短债债券 (QDII)	
基金主代码	206006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 8 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	195,626,173.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华全球中短债债券 (QDII) A 类	鹏华全球中短债债券 (QDII) C 类
下属分级基金的交易代码	206006	008320
报告期末下属分级基金的份额总额	124,837,518.48 份	70,788,654.93 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	鹏华环球发现证券投资基金
基金简称	鹏华环球发现 (QDII-FOF)
基金主代码	206006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 10 月 12 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	35,364,529.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金通过分析全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，在谨慎投资的前提下，以中短期债券为主要投资标的，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、国家/地区配置策略 本基金将根据对全球市场经济发展的判断，以及对不同国家和地区宏观经济、财政和货币政策、证券市场走势、金融市场环境的分析，确定基金资产在不同国家和地区的资产配置比例。 2、债券投资策略 本基金以中短期债券为主要投资标的。本基金债券投资采用的投资策略主要包括中短久期策略、债券类属配置策略、信用债投资策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 （1）中短久期策略 本基金将主要投资于中短久期债券，在此基础上，本基金将根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，

	适当增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。（2）债券类属配置策略 本基金将基于对经济周期及其变化趋势等特征的研究和判断，根据对政府债券、信用债、可转债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定不同经济周期阶段下的债券类属配置策略，并根据经济周期阶段变化及时进行调整。从而有效把握经济不同发展阶段的投资机会，实现基金资产的保值增值。（3）信用债投资策略 本基金将主要通过买入并持有信用风险可承担，期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益。此外，本基金还将通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断，主动采用信用利差投资策略，获取利差收益。（4）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃型或梯形策略构造组合，并进行动态调整。（5）债券选择策略 根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。3、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。本基金将重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素等因素进行自上而下的行业遴选；同时结合对上市公司的竞争力分析、管理层分析等定性分析和对上市公司的关键估值方法（包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等）等定量分析进行自下而上的个股精选。4、汇率避险策略 本基金将紧密跟踪汇率动向，通过对各国/地区的宏观经济形势、货币政策、市场环境以及其他可能影响汇率走势的因素进行深入分析，并结合相关外汇研究机构的成果，研判主要汇率走势，并适度进行外汇远期、期货、期权等汇率衍生品进行对冲，以降低外汇风险。5、金融衍生品投资策略 本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资，包括远期、期权、期货等，以更好地进行组合风险管理，提高组合运作效率，实现投资目标。此外，在严格控制风险的前提下，本基金将适度参与境外证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益。
业绩比较基准	彭博巴克莱短期美元综合债券指数（Bloomberg Barclays Short-Term U.S. Aggregate Bond Index）收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	积极地环球寻找并发现投资机会，通过积极的战略战术资产配置来进行资产在基金、股票、货币市场工具及现金中的分配，在分散风险的前提下，最大化地实现资本的长期增值。
------	--

投资策略	本基金采用多重投资策略，包括自上而下和自下而上方法来增强基金选择流程并提升其效率。衍生品策略将不作为本基金的主要投资策略，且仅用于在适当时候力争规避外汇风险及其他相关风险之目的。 1. 战略资产配置 战略资产配置的目标在于通过资产的灵活配置获得最佳的风险回报。首先通过深入研究，建立基于全球主要市场增长、通货膨胀及货币政策的分析框架，再以宏观经济分析及对全球经济趋势的研究为基础，来决定重点投资区域（地域选择）及资产类别和权重，其后定期进行审核调整。资产类别和地区的适度分散可以有效降低组合的相关性及由此可能产生的单一市场的系统性风险和其他相关风险。此外本基金还将使用适当的风险控制措施来监控管理与战略资产配置相关的风险。 2. 战术资产配置 本基金在战略资产配置的基础上将根据短期内资本市场对不同区域内的不同资产类别的定价判断其与内涵价值的关系，同时考虑投资环境、资金流动、市场预期等因素的变化情况进行适当的战术资产配置及调整。同时，在对微观及宏观经济判断的基础上，本基金还将使用适当的风险控制措施来监控管理与战术资产配置相关的风险。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界指数（MSCI World Index RMB）×50%+摩根斯坦利新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index RMB）×50%
风险收益特征	本基金属于投资全球市场的基金中基金（主要投资股票型公募基金），为证券投资基金中的中高风险品种。长期平均的风险和预期收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金，长期平均的风险低于投资单一市场的股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	李申
	联系电话	0755-82825720	021-60637102
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	田国立

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型后）

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	—	State Street Bank and Trust Company
	中文	—	道富银行

注册地址	-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 0211, United States
办公地址	-	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 0211, United States
邮政编码	-	0211

注：本基金无境外投资顾问。

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人（转型前）

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Eurizon Capital SGR S.p.A.	State Street Bank and Trust Company
	中文	欧利盛资本资产管理股份公司	道富银行
注册地址		意大利米兰嘉多纳（Cadorna）广场 三号	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 0211, United States
办公地址		意大利米兰嘉多纳（Cadorna）广场 三号	One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 0211, United States
邮政编码		20123	0211

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.6 其他相关资料（转型后）

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心 43 层

2.6 其他相关资料（转型前）

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心 43 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月8日(基金合同生效日)-2020年6月30日)	
	鹏华全球中短债债券(QDII)A类	鹏华全球中短债债券(QDII)C类
本期已实现收益	2,925,341.25	474,227.72
本期利润	5,126,707.98	4,183,724.87
加权平均基金份额本期利润	0.0752	0.1819
本期加权平均净值利润率	7.55%	18.08%
本期基金份额净值增长率	4.37%	4.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	6,762,368.85	3,073,946.11
期末可供分配基金份额利润	0.0542	0.0434
期末基金资产净值	130,289,651.87	74,061,527.75
期末基金份额净值	1.0437	1.0462
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.37%	4.62%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放

日或交易所的交易日。

(4) 本基金基金合同于2020年01月08日生效,至2020年06月30日未满6个月。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年1月7日)
本期已实现收益	139,626.71
本期利润	185,878.38
加权平均基金份额本期利润	0.0052
本期加权平均净值利润率	0.52%
本期基金份额净值增长率	0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年1月7日)
期末可供分配利润	371,169.41
期末可供分配基金份额利润	0.0105
期末基金资产净值	35,364,529.25
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年1月7日)
基金份额累计净值增长率	1.06%

注:(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日,即1月7日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华全球中短债债券(QDII)A类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.83%	0.44%	-0.39%	0.18%	4.22%	0.26%
过去三个月	9.99%	0.40%	1.66%	0.21%	8.33%	0.19%
自基金合同生效起至	4.37%	0.61%	5.42%	0.25%	-1.05%	0.36%

鹏华全球中短债债券(QDII)C类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.79%	0.44%	-0.39%	0.18%	4.18%	0.26%
过去三个月	9.88%	0.40%	1.66%	0.21%	8.22%	0.19%
自基金合同生效起至	4.62%	0.60%	5.42%	0.25%	-0.80%	0.35%

注：业绩比较基准=彭博巴克莱短期美元综合债券指数(Bloomberg Barclays Short-Term U.S. Aggregate Bond Index) 收益率

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华全球中短债债券(QDII) A类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华全球中短债债券(QDII)C类累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2020 年 01 月 08 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去六个月	0.56%	0.46%	-0.25%	0.67%	0.81%	-0.21%
过去一年	6.94%	0.55%	9.43%	0.54%	-2.49%	0.01%
过去三年	1.57%	0.84%	26.48%	0.63%	-24.91%	0.21%
自基金合同生效起至今	1.06%	0.96%	81.81%	0.79%	-80.75%	0.17%

注：业绩比较基准=摩根斯坦利世界指数（MSCI World Index RMB）×50%+摩根斯坦利新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index RMB）×50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华环球发现(QDII-FOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2010 年 10 月 13 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 22 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尤柏年	本基金基金经理	2020-01-08	-	16 年	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，16 年证券基金从业经验。历任澳大利亚

					BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师, 华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职; 2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任国际业务部副总经理, 现担任国际业务部总经理、基金经理。2014 年 08 月担任鹏华全球高收益债基金基金经理, 2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现 (QDII-FOF) 基金基金经理, 2015 年 07 月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理, 2016 年 12 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理, 2017 年 11 月担任鹏华港美互联股票 (LOF) 基金基金经理, 2017 年 11 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金基金经理, 2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华香港银行指数 (LOF) 基金基金经理, 2020 年 01 月担任鹏华全球中短债债券型证券投资基金 (QDII) 基金经理。尤柏年先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	---

注: 1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日; 担任新成立基金基金经理的, 任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介 (转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尤 柏 年	本基金基金经理	2014-09-13	-	16 年	尤柏年先生, 国籍中国, 经济学博士, 16 年证券基金从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师, 华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职; 2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任国际业务部副总经理, 现担任国际业务部总经理、基金经理。2014 年 08 月担任鹏华全球高收益债基金基金经理, 2014 年 09 月至 2020 年 01 月担任鹏华环球发现 (QDII-FOF) 基金基金经理, 2015 年 07 月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金

					经理，2016 年 12 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华港美互联股票(LOF)基金基金经理，2017 年 11 月至 2019 年 08 月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华香港中小企业指数(LOF)基金基金经理，2020 年 01 月担任鹏华全球中短债债券 A 类人民币(QDII)基金基金经理。尤柏年先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	---

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型后）

注：无。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型前）

注：无。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：无。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超

过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受新冠疫情影响，今年一季度全球各类资产价格均出现大幅下跌，美元债板块也受到了基本面及资金面的双重冲击，以彭博巴克莱亚洲美元高收益债指数来衡量，仅一季度亚洲美元高收益债板块下跌了 12.5%。

市场在美联储于 3 月底推出无限量化宽松政策后出现企稳反弹，海外市场流动性持续改善，在投资者对疫情拐点和经济重启的预期下，二季度美元债市场整体出现较大反弹。从总回报指数来看，二季度中资美元债高收益债反弹幅度约 9%，已基本收回一季度的跌幅。其中，中资房企美元债在一季度的跌幅较大，二季度反弹幅度也大。从二季度的地产数据来看，地产投资及销售情况均有明显改善，房地产开发投资同比增速从 4 月的 6.7%加快至 5 月的 8.4%，前 100 大房企 5 月份的总销售额也由 4 月份的下落转正至增长 16.9%，1-5 月累计销售额同比跌幅大幅收窄。地产投资及销售的好转缓解了投资者对地产企业偿债压力的担忧，进一步提升了整体风险偏好。

本基金今年一季度完成建仓，以中短久期海外债策略为主，二季度以来随着剩余期限的缩短，净值迅速修复，今年的净值表现实现了产品的设计初衷。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，转型前鹏华环球发现证券投资基金份额净值增长率为 0.56%，同期业绩比较基准增长率为-0.25%；转型后鹏华全球中短债债券(QDII)A 份额净值增长率 4.37%，业绩比较基准增长率 5.42%；鹏华全球中短债债券(QDII)C 份额净值增长率 4.62%，业绩比较基准增长率 5.42%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后续来看，基准利率方面，美债收益率出现大幅回升的概率不大，短端安全性高于长端。中资美元债方面，我们认为随着总量流动性的稳定和局部信用缓解，金融市场为缓解流动性而采取的恐慌性抛售行为基本上已告一段落，在疫情和复工进展及国际政治经济环境不发生明显恶化的情形下，未来再次发生类似 3 月份的流动性冲击概率不大。但近期中美摩擦升级、美国针对香港措施、汇率压力及国际政治经济环境变化可能对市场风险偏好产生负面影响，短期可能存在波动加大的可能。

权益投资方面，本基金会以绝对收益角度参与一些确定性较高的投资机会，今年受疫情影响，权益类资产中出现不少低估值、下行空间小、且具备高成长空间的公司。本基金二季度增加了权益类资产的投资，二季度港股及国内市场逐渐从疫情中恢复，走出一波反弹行情，为本基金提供

了额外收益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本公司成立投资品种估值小组，组成人员包括基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员。其中，超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，基金经理不参与或决定基金日常估值。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金A类份额期末可供分配利润为6,762,368.85元，期末基金份额净值1.0437元；本基金C类份额期末可供分配利润为3,073,946.11元，期末基金份额净值1.0462元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)

报告截止日：2020年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年6月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	44,715,468.52
结算备付金		1,045,145.39
存出保证金		366,240.92
交易性金融资产	6.4.7.2	178,056,047.78
其中：股票投资		18,743,343.82
基金投资		2,449,356.21
债券投资		156,863,347.75
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	3,196,317.31
应收股利		37,513.54
应收申购款		20,305,710.93
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		247,722,444.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		39,437,121.96
应付赎回款		3,648,095.92
应付管理人报酬		113,210.34
应付托管费		25,157.85

应付销售服务费		19,625.64
应付交易费用	6.4.7.7	29,782.17
应交税费		24,980.04
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	73,290.85
负债合计		43,371,264.77
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	194,315,937.95
未分配利润	6.4.7.10	10,035,241.67
所有者权益合计		204,351,179.62
负债和所有者权益总计		247,722,444.39

注：(1)报告截止日2020年06月30日，基金份额总额195,626,173.41份，其中鹏华全球中短债债券(QDII)A类人民币份额基金份额总额123,530,141.04份，基金份额净值1.0437元；鹏华全球中短债债券(QDII)A类美元现汇份额基金份额总额1,307,377.44份，基金份额净值0.1474美元；鹏华全球中短债债券(QDII)C类人民币份额基金份额总额70,779,005.57份，基金份额净值1.0462元；鹏华全球中短债债券(QDII)C类美元现汇份额基金份额总额9,649.36份，基金份额净值0.1478美元。

(2)本基金基金合同于2020年01月08日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.2 利润表

会计主体：鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)

本报告期：2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
一、收入		10,009,296.34
1. 利息收入		2,707,771.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,361.50
债券利息收入		2,678,410.48
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,762,773.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,287,371.67
基金投资收益	6.4.7.13	418,961.48
债券投资收益	6.4.7.14	571,227.83

资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-655,876.78
股利收益	6.4.7.17	141,089.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,908,468.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-377,244.21
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	7,526.32
减：二、费用		698,863.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	391,877.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,083.76
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	44,483.21
4. 交易费用	6.4.7.20	116,616.27
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		8,547.35
7. 其他费用	6.4.7.21	50,255.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,310,432.85
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,310,432.85

注：本财务报表的实际编制期间为2020年01月08日（基金合同生效日）至2020年06月30日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)

本报告期：2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	34,993,359.84	371,169.41	35,364,529.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	9,310,432.85	9,310,432.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	159,322,578.11	353,639.41	159,676,217.52
其中：1. 基金申	167,945,275.71	596,022.82	168,541,298.53

购款			
2. 基金赎回款	-8,622,697.60	-242,383.41	-8,865,081.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	194,315,937.95	10,035,241.67	204,351,179.62

注：本财务报表的实际编制期间为 2020 年 01 月 08 日（基金合同生效日）至 2020 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII) (原鹏华环球发现证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]470 号《关于核准鹏华环球发现证券投资基金募集的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 534,126,065.21 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2010)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》于 2010 年 10 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 534,464,662.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 338,597.31 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行，境外投资顾问为意大利欧利盛资本资产管理股份公司。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华环球发现证券投资基金及鹏华美国房地产证券投资基金增设美元现汇基金份额的公告》，本基金自 2018 年 12 月 4 日起增设美元现汇基金份额。投资者申购时可以自主选择基金份额类别，并交付相应币种的款项，赎回基金份额时收到对应币种的款

项。

根据本基金基金份额持有人大会于2019年12月26日表决通过的《关于鹏华环球发现证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》和本基金基金管理人于2019年12月27日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华环球发现证券投资基金实施转型的提示性公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司确认协商一致，基金管理人将《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》、《鹏华环球发现证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》、《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)托管协议》，并据此编制《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)招募说明书》。《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》、《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)托管协议》自鹏华环球发现证券投资基金基金份额折算基准日的次一工作日起，即2020年1月8日起生效，《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为境内境外市场。针对境外市场，本基金可投资于下列金融产品或工具：银行存款、可转让存单、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证、美国存托凭证和房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。针对境内市场，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票(包含中小板、创业板及其他依法上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等资产；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金以中短期债券为主要投资对象。本基金基金投资部分的比例为：对债券的投资比例不低于基金资产的80%。其中，投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于境外发行的债券资产的比例不低于非现金基金资产的60%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的

5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金所指的中短期债券是指剩余期限不超过三年的债券资产。本基金的业绩比较基准为：彭博巴克莱短期美元综合债券指数(Bloomberg Barclays Short-Term U.S. Aggregate Bond Index)收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年01月08日(基金合同生效日)至2020年06月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况以及2020年01月08日(基金合同生效日)至2020年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

—

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2020年01月08日(基金合同生效日)至2020年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金

交易所在地适用的预缴所得税后的净额于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资；美元现汇基金份额的每份额分配金额为人民币基金份额的每份额分配数额按照权益登记日前一工作日美元估值汇率折算后的美元金额。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率

缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	44,715,468.52
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计	44,715,468.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,296,891.00	18,743,343.82	2,446,452.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	832,572.72	843,310.00
	银行间市场	-	-
	OTC 市场	151,784,648.63	156,020,037.75
	合计	152,617,221.35	156,863,347.75
资产支持证券	-	-	-
基金	2,112,827.78	2,449,356.21	336,528.43
其他	-	-	-
合计	171,026,940.13	178,056,047.78	7,029,107.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-14, 354, 220. 00	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-14, 354, 220. 00	-	-	

注：（1）衍生金融资产项下的期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）截止本报告期末，本基金持有新加坡人民币期货 2012 合约共-20 张，合约市值折人民币元-14,274,000.00 元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	3,277.31
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	157.44
应收债券利息	3,192,881.16
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	1.40
合计	3,196,317.31

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	29,782.17
银行间市场应付交易费用	—
合计	29,782.17

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,455.59
应付证券出借违约金	—
预提费用	69,835.26
合计	73,290.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华全球中短债债券(QDII)A类

项目	本期 2020 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	35,364,529.16	34,993,359.84
2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	96,858,380.21	95,841,800.52
本期赎回（以“-”号填列）	-7,385,390.89	-7,307,877.34
本期末	124,837,518.48	123,527,283.02

鹏华全球中短债债券(QDII)C 类

项目	本期 2020 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-

2020年1月8日(基金合同生效日)至 2020年6月30日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2020年1月8日(基金合同生效日)至 2020年6月30日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	72,103,475.19	72,103,475.19
本期赎回(以“-”号填列)	-1,314,820.26	-1,314,820.26
本期末	70,788,654.93	70,788,654.93

注：1. 申购含红利再投份额。

2. 根据《鹏华基金管理有限公司关于鹏华环球发现证券投资基金实施转型的提示性公告》及《鹏华环球发现证券投资基金基金份额折算和变更登记结果暨鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同生效的公告》，原鹏华环球发现证券投资基金人民币份额变更登记为鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)A类人民币份额，原鹏华环球发现证券投资基金美元份额变更登记为鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)A类美元份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华全球中短债债券(QDII)A类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	1,554,532.91	-1,183,363.50	371,169.41
本期利润	2,925,341.25	2,201,366.73	5,126,707.98
本期基金份额 交易产生的变 动数	7,660,161.80	-6,395,670.34	1,264,491.46
其中：基金申 购款	8,310,848.62	-6,834,087.44	1,476,761.18
基金赎 回款	-650,686.82	438,417.10	-212,269.72
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	12,140,035.96	-5,377,667.11	6,762,368.85
鹏华全球中短债债券(QDII)C类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	0.00	0	0

本期利润	474,227.72	3,709,497.15	4,183,724.87
本期基金份额交易产生的变动数	2,599,718.39	-3,510,570.44	-910,852.05
其中：基金申购款	2,652,995.31	-3,533,733.67	-880,738.36
基金赎回款	-53,276.92	23,163.23	-30,113.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,073,946.11	198,926.71	3,272,872.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	22,557.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	874.72
其他	5,929.19
合计	29,361.50

注：其他包含认/申购款利息收入，结算保证金利息收入等。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,287,371.67
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,287,371.67

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	21,648,328.81
减：卖出股票成本总额	20,360,957.14
买卖股票差价收入	1,287,371.67

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	12,386,217.75
减：卖出/赎回基金成本总额	11,967,256.27
基金投资收益	418,961.48

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	571,227.83
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	571,227.83

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	17,654,501.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,737,625.11
减：应收利息总额	345,649.04
买卖债券差价收入	571,227.83

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
货币期货投资收益	-655,876.78
—	—

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	80,120.00
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	60,969.23
合计	141,089.23

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,808,290.00
股票投资	1,910,888.15
债券投资	4,246,126.40
资产支持证券投资	—
基金投资	-348,724.55

贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	80,220.00
权证投资	-
期货投资	80,220.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-19,958.82
合计	5,908,468.82

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年 6月30日
基金赎回费收入	7,526.32
合计	7,526.32

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	116,616.27
银行间市场交易费用	-
合计	116,616.27

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6 月30日
审计费用	28,687.75
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	21,568.08
合计	50,255.83

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
道富银行(State Street Bank and Trust Company)	境外资产托管人
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2020 年 01 月 08 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 8 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	13,205,825.82	35.44

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国信证券	13,020.08	38.10	10,649.49	35.76

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×佣金比率-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	391,877.07
其中：支付销售机构的客户维护费	26,554.14

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬年费率为0.90%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.90%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

3、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,083.76

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为0.20%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华全球中短债债券 (QDII)A类	鹏华全球中短债债券 (QDII)C类	合计
鹏华基金公司	-	43,979.64	43,979.64
合计	-	43,979.64	43,979.64

注：1、支付基金销售机构的C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，逐日计提，按月支付，A类基金份额不支付销售服务费。日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.40%÷当年天数。

2、本基金转型后基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	鹏华全球中短债债券(QDII)A类	鹏华全球中短债债券(QDII)C类
基金合同生效日（2020年1月8日）持有的基金份额	29,861,172.24	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,861,172.24	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.9200%	-

注：(1)2020年1月7日，鹏华环球发现证券投资基金基金份额变更登记为鹏华全球中短债债券证券投资基金，折算后的基金份额为29,861,172.24份。

(2)本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：1、本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

2、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
道富银行	11,463,877.98	216.44
中国建设银行	33,251,590.54	22,341.15

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交

易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 76.76%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	18,397,581.61
未评级	-
合计	18,397,581.61

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债；A-1 以下包含未评级的超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	138,465,766.14
未评级	-
合计	138,465,766.14

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或通过场外的交易方式变现，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发

行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2020年6月30日					
资产					
银行存款	44,715,468.52	-	-	-	44,715,468.52
结算备付金	1,045,145.39	-	-	-	1,045,145.39
存出保证金	366,240.92	-	-	-	366,240.92
交易性金融资产	72,553,621.84	81,101,402.74	3,208,323.17	21,192,700.03	178,056,047.78
应收利息	-	-	-	3,196,317.31	3,196,317.31
应收股利	-	-	-	37,513.54	37,513.54
应收申购款	-	-	-	20,305,710.93	20,305,710.93
资产总计	118,680,476.67	81,101,402.74	3,208,323.17	44,732,241.81	247,722,444.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,648,095.92	3,648,095.92
应付管理人报酬	-	-	-	113,210.34	113,210.34
应付托管费	-	-	-	25,157.85	25,157.85
应付证券清算款	-	-	-	39,437,121.96	39,437,121.96
应付销售服务费	-	-	-	19,625.64	19,625.64
应付交易费用	-	-	-	29,782.17	29,782.17
应交税费	-	-	-	24,980.04	24,980.04
其他负债	-	-	-	73,290.85	73,290.85
负债总计	-	-	-	43,371,264.77	43,371,264.77
利率敏感度缺口	118,680,476.67	81,101,402.74	3,208,323.17	1,360,977.04	204,351,179.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年6月30日）
	市场利率下降25个基点	469,975.71
	市场利率上升25个基点	-469,945.91

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	32,682,685.13	5,485.12	30,829.78	32,719,000.03
结算备付金	686,823.78	111,669.81	-	798,493.59
交易性金融资产	146,525,522.41	19,758,163.92	3,957,341.45	170,241,027.78
应收股利	21,513.54	-	-	21,513.54
应收利息	3,044,133.38	147,736.23	-	3,191,869.61
资产合计	182,960,678.24	20,023,055.08	3,988,171.23	206,971,904.55
以外币计价的负债				
应付证券清算款	39,243,314.55	-	-	39,243,314.55
负债合计	39,243,314.55	-	-	39,243,314.55
资产负债表外汇风险敞口净额	143,717,363.69	20,023,055.08	3,988,171.23	167,728,590.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	

分析	所有外币相对人民币升值 5%	8,386,426.80
	所有外币相对人民币贬值 5%	-8,386,426.80

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于全球市场中依法可投资的公募基金及股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于中短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于境外发行的债券资产的比例不低于非现金基金资产的 60%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	18,743,343.82	9.17
交易性金融资产—基金投资	2,449,356.21	1.20
交易性金融资产—债券投资	19,443,430.17	9.51

交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	40,636,130.20	19.89

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2020年6月30日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华环球发现证券投资基金

报告截止日：2020年1月7日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年1月7日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	17,653,775.40	15,038,403.31
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	17,862,477.78	20,274,590.91
其中：股票投资		5,780,801.18	6,502,314.74
基金投资		12,081,676.60	13,772,276.17
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		1,279,750.78	1,529,395.81
应收利息	6.4.7.5	508.82	424.74
应收股利		6,186.38	33,316.24
应收申购款		—	—

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		36,802,699.16	36,876,131.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年1月7日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		344,603.16	541,962.58
应付赎回款		897,679.24	170,948.94
应付管理人报酬		10,261.03	44,779.07
应付托管费		2,394.24	10,448.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		27,079.63	26,264.54
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	156,152.61	155,054.06
负债合计		1,438,169.91	949,457.68
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	34,993,359.84	35,733,125.54
未分配利润	6.4.7.10	371,169.41	193,547.79
所有者权益合计		35,364,529.25	35,926,673.33
负债和所有者权益总计		36,802,699.16	36,876,131.01

注：(1)报告截止日2020年01月07日,基金份额总额为35,364,529.16份,其中鹏华环球发现(QDII-FOF)基金人民币基金份额35,189,965.25份,基金份额净值1.000元;鹏华环球发现(QDII-FOF)基金美元现汇基金份额174,563.91份,基金份额净值0.143美元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华环球发现证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年1月7日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至2020 年1月7日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
一、收入		207,413.13	4,893,216.13
1. 利息收入		363.77	7,258.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	363.77	7,258.92
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		165,204.87	339,803.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,547.02	-526,340.44
基金投资收益	6.4.7.13	140,647.24	760,043.93
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,010.61	106,099.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	46,286.12	4,391,663.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-4,441.63	150,658.99
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	3,831.42
减：二、费用		21,534.75	495,702.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,261.03	254,283.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,394.24	59,332.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	7,146.19	135,111.16
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		540.78	4,550.93
7. 其他费用	6.4.7.21	1,192.51	42,423.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		185,878.38	4,397,513.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		185,878.38	4,397,513.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华环球发现证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年1月7日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
----	---------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	35,733,125.54	193,547.79	35,926,673.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	185,878.38	185,878.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-739,765.70	-8,256.76	-748,022.46
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-739,765.70	-8,256.76	-748,022.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	34,993,359.84	371,169.41	35,364,529.25
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	40,704,863.18	-6,864,403.52	33,840,459.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	4,397,513.74	4,397,513.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-5,047,804.45	490,657.56	-4,557,146.89
其中: 1. 基金申购款	874,018.78	-79,300.04	794,718.74
2. 基金赎回款	-5,921,823.23	569,957.60	-5,351,865.63
四、本期向基金	-	-	-

份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	35,657,058.73	-1,976,232.22	33,680,826.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华环球发现证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 470 号《关于核准鹏华环球发现证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 534,126,065.21 元,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》于 2010 年 10 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 534,464,662.52 份基金份额,其中认购资金利息折合 338,597.31 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为道富银行,境外投资顾问为欧利盛资本资产管理股份公司。

本基金基金份额持有人大会于 2019 年 12 月 26 日表决通过了《关于鹏华环球发现证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》,基金名称将由“鹏华环球发现证券投资基金”变更为“鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)”。本基金赎回选择期为 2019 年 12 月 27 日至 2020 年 1 月 3 日,赎回选择期结束之日后 5 个工作日内,本基金管理人将根据持有人大会决议执行基金的正式转型,将原鹏华环球发现证券投资基金的基金份额结转为鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)的基金份额。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华环球发现证券投资基金及鹏华美国房地产证券投资基金增设美元现汇基金份额的公告》,本基金自 2018 年 12 月 4 日起增设美元现汇基金份额。投资者申购时可以自主选择基金份额类别,并交付相应币种的款项,赎回基金份额时收到对应币种的款

项。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为公募基金(含交易型开放式指数基金(ETF))、股票、货币市场工具，及相关法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金基金投资部分的比例为基金资产的 60%-95%；股票、现金、货币市场工具以及相关法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具合计不高于本基金基金资产的 40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利世界指数(MSCI World Index RMB)×50%+摩根斯坦利新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index RMB)×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 01 月 07 日(基金合同失效前日)期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 01 月 07 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 01 月 07 日(基金合同失效前日)期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计估计变更的说明

无。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 7 日
活期存款	17,653,775.40
定期存款	—

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	17,653,775.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 7 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,245,236.51	5,780,801.18	535,564.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	11,396,423.62	12,081,676.60	685,252.98
其他	-	-	-
合计	16,641,660.13	17,862,477.78	1,220,817.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 7 日
应收活期存款利息	508.82
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	508.82

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

注：无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 7 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5.10
应付证券出借违约金	-
预提费用	156,147.51
合计	156,152.61

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 7 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,733,125.54	35,733,125.54
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-739,765.70	-739,765.70
2020 年 01 月 07 日 基金拆分/ 份额折算前	34,993,359.84	34,993,359.84
基金拆分/份额折算调整	371,169.32	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	35,364,529.16	34,993,359.84

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、鹏华环球发现证券投资基金基金份额持有人大会于 2019 年 12 月 26 日表决通过了《关于鹏华环球发现证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，鹏华基金管理有限公司决定对鹏华环球发现证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，转型为鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII），基金份额折算基准日为 2020 年 1 月 7 日。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,446,195.16	-1,252,647.37	193,547.79
本期利润	139,626.71	46,251.67	185,878.38
本期基金份额交易产生的变动数	-31,288.96	23,032.20	-8,256.76
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-31,288.96	23,032.20	-8,256.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,554,532.91	-1,183,363.50	371,169.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
活期存款利息收入	363.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	363.77

注：其他包含认/申购款利息收入，结算保证金利息收入等。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
股票投资收益——买卖股票差价收入	21,547.02
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	21,547.02

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
卖出股票成交总额	1,766,808.30
减：卖出股票成本总额	1,745,261.28
买卖股票差价收入	21,547.02

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
卖出/赎回基金成交总额	1,841,102.58
减：卖出/赎回基金成本总额	1,700,455.34
基金投资收益	140,647.24

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	3,010.61
合计	3,010.61

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
1. 交易性金融资产	46,573.18
股票投资	36,717.41
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	9,855.77
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	287.06
合计	46,286.12

6.4.7.19 其他收入

注：无。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
交易所市场交易费用	7,146.19
银行间市场交易费用	-
合计	7,146.19

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日
审计费用	1,147.51
信息披露费	-

证券出借违约金	—
银行汇划费用	45.00
合计	1,192.51

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

《鹏华环球发现证券投资基金基金合同》自2020年1月8日起失效，《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》于同日起生效，同时本基金更名为鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
道富银行(State Street Bank and Trust Company)	境外资产托管人
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 基金交易

注：无。

6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1 月7日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,261.03	254,283.80
其中：支付销售机构的客户维护费	1,852.63	32,089.86

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬年费率为1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年1 月7日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,394.24	59,332.90

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为0.35%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年1月7日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
基金合同生效日（2010年10月12日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	29,547,763.55	29,547,763.55
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	313,408.69	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	29,861,172.24	29,547,763.55
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.9200%	82.8665%

注：2020年1月7日，鹏华环球发现证券投资基金基金份额变更登记为鹏华全球中短债债券证券投资基金，折算后的基金份额为29,861,172.24份。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年1月7日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
道富银行	16,755,972.53	255.02	5,737,924.24	6,645.24
中国建设银行	897,802.87	108.75	232,305.41	608.04

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(2020年1月7日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为基金中的基金，主要投资于全球市场中依法可投资的公募基金及股票。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各

业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2020年1月7日，本基金未持有信用类债券（2019年12月31日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或通过场外的交易方式变现，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，所有已售出而未回购证券总市值不得超过本基金总资产的 50%。

于 2020 年 1 月 7 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发

行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 1 月 7 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,653,775.40	-	-	-	17,653,775.40
交易性金融资产	-	-	-	17,862,477.78	17,862,477.78
应收利息	-	-	-	508.82	508.82
应收股利	-	-	-	6,186.38	6,186.38
应收证券清算款	-	-	-	1,279,750.78	1,279,750.78
资产总计	17,653,775.40	-	-	19,148,923.76	36,802,699.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	897,679.24	897,679.24
应付管理人报酬	-	-	-	10,261.03	10,261.03
应付托管费	-	-	-	2,394.24	2,394.24
应付证券清算款	-	-	-	344,603.16	344,603.16
应交税费	-	-	-	27,079.63	27,079.63
其他负债	-	-	-	156,152.61	156,152.61
负债总计	-	-	-	1,438,169.91	1,438,169.91
利率敏感度缺口	17,653,775.40	-	-	17,710,753.85	35,364,529.25
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,038,403.31	-	-	-	15,038,403.31
交易性金融资产	-	-	-	20,274,590.91	20,274,590.91
应收利息	-	-	-	424.74	424.74
应收股利	-	-	-	33,316.24	33,316.24
应收证券清算款	-	-	-	1,529,395.81	1,529,395.81
资产总计	15,038,403.31	-	-	21,837,727.70	36,876,131.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	170,948.94	170,948.94
应付管理人报酬	-	-	-	44,779.07	44,779.07
应付托管费	-	-	-	10,448.49	10,448.49
应付证券清算款	-	-	-	541,962.58	541,962.58
应交税费	-	-	-	26,264.54	26,264.54
其他负债	-	-	-	155,054.06	155,054.06
负债总计	-	-	-	949,457.68	949,457.68
利率敏感度缺口	15,038,403.31	-	-	20,888,270.02	35,926,673.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 1 月 7 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。

（2019 年 12 月 31 日：未持有），因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无

重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年1月7日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	11,697,053.17	5,240,330.11	2.96	16,937,386.24
交易性金融资产	7,820,328.18	10,042,149.60	—	17,862,477.78
应收股利	6,186.38	—	—	6,186.38
应收利息	251.65	8.75	—	260.40
应收证券清算款	1,279,750.78	—	—	1,279,750.78
资产合计	20,803,570.16	15,282,488.46	2.96	36,086,061.58
以外币计价的负债				
应付证券清算款	—	344,603.16	—	344,603.16
应付赎回款	205,720.21	—	—	205,720.21
负债合计	205,720.21	344,603.16	—	550,323.37
资产负债表外汇风险敞口净额	20,597,849.95	14,937,885.30	2.96	35,535,738.21
项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	9,583,967	4,656,973.26	2.95	14,240,943.95

	. 74			
交易性金融资产	9,519,023 . 15	10,755,567.76	-	20,274,590.91
应收股利	33,316.24	-	-	33,316.24
应收利息	258.33	24.78	-	283.11
应收证券清算款	1,529,395 . 81	-	-	1,529,395.81
资产合计	20,665,96 1.27	15,412,565.80	2.95	36,078,530.02
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	541,962.58	-	541,962.58
负债合计	-	541,962.58	-	541,962.58
资产负债表外汇风险敞口净额	20,665,96 1.27	14,870,603.22	2.95	35,536,567.44

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年1月7日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值5%	1,776,773.89	1,776,814.22
	所有外币相对人民币贬值5%	-1,776,773.89	-1,776,814.22

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于全球市场中依法可投资的公募基金及股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取战略性资产配置和战术性资产配

置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金基金投资部分的比例为基金资产的 60%-95%；股票、现金、货币市场工具以及相关法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具合计不高于本基金基金资产的 40%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 1 月 7 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,780,801.18	16.35	6,502,314.74	18.10
交易性金融资产—基金投资	12,081,676.60	34.16	13,772,276.17	38.33
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	17,862,477.78	50.51	20,274,590.91	56.43

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2020 年 1 月 7 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）	

			31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	1,148,730.09	1,414,593.18
	业绩比较基准下降 5%	-1,148,730.09	-1,414,593.18

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	18,743,343.82	7.57
	其中：普通股	18,743,343.82	7.57
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	2,449,356.21	0.99
3	固定收益投资	156,863,347.75	63.32
	其中：债券	156,863,347.75	63.32
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	45,760,613.91	18.47
8	其他各项资产	23,905,782.70	9.65
9	合计	247,722,444.39	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,137,883.20 元，占净值比 2.02%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	11,141,044.99	5.45
中国	6,971,710.00	3.41
美国	630,588.83	0.31
合计	18,743,343.82	9.17

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
半导体产品	1,973,030.40	0.97
电子设备和仪器	473,550.00	0.23
多行业控股	1,263.76	—
多种金属与采矿	917,500.00	0.45
房地产经营公司	1,561,982.40	0.76
工业机械	3,215,850.00	1.57
环境与设施服务	5,441,179.39	2.66
家用电器	1,923,380.00	0.94
零售业房地产投资信托	629,325.07	0.31
通信设备	2,606,282.80	1.28
合计	18,743,343.82	9.17

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	BEIJING ENTERPRISES URBAN RE	北控城市资源	3718 HK	香港联合交易所	中国香港	4,380,000	5,441,179.39	2.66
2	INFORE ENVIRONMENT TECHNOL-A	盈峰环境	000967 SZ	深圳证券交易所	中国	389,800	3,215,850.00	1.57
3	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所（港股通）	中国香港	100,000	2,164,852.80	1.06
3	ZTE CORP-A	中兴通讯	000063 SZ	深圳证券交易所	中国	11,000	441,430.00	0.22

				交易所				
4	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中 芯 国 际	981 HK	香港 联合 交易 所 (港 股 通)	中国 香港	80,000	1,973,030.40	0.97
5	GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	格 力 电 器	000651 SZ	深圳 证券 交易 所	中国	34,000	1,923,380.00	0.94
6	CENTRAL CHINA NEW LIFE LTD	建 业 新 生活	9983 HK	香港 联合 交易 所	中国 香港	200,000	1,561,982.40	0.76
7	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	洛 阳 钼 业	603993 SH	上海 证券 交易 所	中国	250,000	917,500.00	0.45
8	SIMON PROPERTY GROUP INC	西 蒙 房 地 产 集 团 公 司	SPG US	美国 证券 交易 所	美国	1,300	629,325.07	0.31
9	HANGZHOU CENTURY CO LTD-A	思 创 医 惠	300078 SZ	深圳 证券 交易 所	中国	35,000	473,550.00	0.23
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	伯 克 希 尔 哈 撒 韦 公 司	BRK/B US	美国 证券 交易 所	美国	1	1,263.76	0

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	ZTE CORP-H	763 HK	5,747,539.81	2.81
2	BEIJING ENTERPRISES URBAN RE	3718 HK	3,065,036.81	1.50

3	INFORE ENVIRONMENT TECHNOL-A	000967 SZ	3,039,616.00	1.49
4	CENTRAL CHINA NEW LIFE LTD	9983 HK	2,867,031.20	1.40
5	GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	000651 SZ	2,238,924.00	1.10
6	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,794,914.45	0.88
7	BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	300070 SZ	1,419,190.00	0.69
8	NEWCAPEC ELECTRONICS CO LT-A	300248 SZ	1,126,538.00	0.55
9	FUJIAN LONGMA ENVIRONMENTA-A	603686 SH	958,669.00	0.47
10	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	603993 SH	913,000.00	0.45
11	FUCHUN TECHNOLOGY CO LTD - A	300299 SZ	861,347.00	0.42
12	FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	601138 SH	853,200.00	0.42
13	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	593,230.89	0.29
14	ZTE CORP-A	000063 SZ	476,686.08	0.23
15	HANGZHOU CENTURY CO LTD-A	300078 SZ	462,773.00	0.23
16	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1876 HK	461,673.53	0.23
17	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	409,946.87	0.20
18	INSUR ELECTRONIC INFORMAT-A	000977 SZ	388,601.00	0.19
19	LUONIUSHAN CO LTD - A	000735 SZ	383,590.00	0.19
20	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	603799 SH	372,600.00	0.18

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	ZTE CORP-H	763 HK	4,455,406.06	2.18
2	BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	300070 SZ	1,560,064.44	0.76
3	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	1,428,556.12	0.70
4	FUJIAN LONGMA ENVIRONMENTA-A	603686 SH	1,419,386.00	0.69
5	CENTRAL CHINA NEW LIFE LTD	9983 HK	1,316,036.00	0.64
6	NEWCAPEC ELECTRONICS CO LT-A	300248 SZ	1,166,928.01	0.57
7	CHINA VANKE CO LTD-H	2202 HK	1,099,966.73	0.54
8	FUCHUN TECHNOLOGY CO LTD - A	300299 SZ	974,000.00	0.48
9	FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	601138 SH	914,400.00	0.45
10	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	795,144.32	0.39
11	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	608,846.53	0.30
12	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	1772 HK	456,143.66	0.22
13	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1876 HK	417,620.31	0.20
14	INSUR ELECTRONIC INFORMAT-A	000977 SZ	408,800.00	0.20
15	EIT ENVIRONMENTAL DEVELOPM-A	300815 SZ	407,621.00	0.20
16	CHINASOFT	354 HK	374,005.79	0.18

	INTERNATIONAL LTD			
17	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	368,861.49	0.18
18	LUONIUSHAN CO LTD - A	000735 SZ	357,120.00	0.17
19	WANGNENG ENVIRONMENT CO LT-A	002034 SZ	356,022.00	0.17
20	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	603799 SH	355,000.00	0.17

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	31,412,611.63
卖出收入（成交）总额	21,648,328.81

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A+至 A-	1,526,835.77	0.75
B+至 B-	40,412,118.02	19.78
BB+至 BB-	-	-
BBB+至 BBB-	2,365,013.17	1.16
CCC+至 CCC-	769,612.45	0.38
未评级	111,789,768.34	54.70
合计	156,863,347.75	76.76

注：上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	EVERRE 4 1/4 02/14/23	CHINA EVERGRANDE GROUP	9,134,400	8,617,118.93	4.22
2	FUTLAN 7 1/2 01/22/21	FUTURE LAND DEVELOPMENT	7,716,655	7,803,081.54	3.82

3	PWRLNG 7 1/8 11/08/22	POWERLONG REAL ESTATE	7,079,500	7,177,409.49	3.51
4	EVERRE 89 05/24/21	CHINA EVERGRANDE GROUP	6,371,550	6,254,377.20	3.06
5	YANGOG 12 1/2 02/20/22	YANGO CAYMAN INVESTMENT	5,663,600	5,625,144.16	2.75

注：数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：（1）衍生金融资产项下的期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）截止本报告期末，本基金持有新加坡人民币期货 2012 合约共-20 张，合约市值折人民币-14,274,000.00 元。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	DOUBLELINE INCOME SOLUTIONS	债券型	Closed-End Fund	Doubleline Capital LP	2,449,356.21	1.20

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	366,240.92
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	37,513.54
4	应收利息	3,196,317.31
5	应收申购款	20,305,710.93
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	23,905,782.70

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,780,801.18	15.71
	其中：普通股	5,780,801.18	15.71
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	12,081,676.60	32.83
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	17,653,775.40	47.97
8	其他各项资产	1,286,445.98	3.50

9	合计	36,802,699.16	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	5,780,801.18	16.35
合计	5,780,801.18	16.35

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
建筑机械与重型卡车	1,459,322.92	4.13
通信设备	1,151,861.15	3.26
房地产开发	1,127,479.34	3.19
电脑与外围设备	690,220.30	1.95
互动媒体与服务	622,166.37	1.76
电子制造服务	374,646.20	1.06
多种金属与采矿	355,104.90	1.00
合计	5,780,801.18	16.35

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	SINOTRUK HONG KONG LTD	中国重汽	3808 HK	香港联合交易所	中国	100,000	1,459,322.92	4.13
2	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国	50,000	1,151,861.15	3.26
3	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	2202 HK	香港联合交易所	中国	38,000	1,127,479.34	3.19
4	XIAOMI CORP-CLASS B	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国	70,000	690,220.30	1.95
5	TENCENT HOLDINGS	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国	1,800	622,166.37	1.76

	LTD			交易所				
6	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科技	2018 HK	香港交易所	中国	6,500	374,646.20	1.06
7	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	赣锋锂业	1772 HK	香港交易所	中国	19,000	355,104.90	1.00

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	ZTE CORP-H	763 HK	444,354.79	1.24
2	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	1772 HK	343,654.96	0.96
3	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	199,020.56	0.55

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	1513 HK	935,597.96	2.60
2	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	831,210.34	2.31

注：1、本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

2、卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	987,030.31
------------	------------

卖出收入（成交）总额	1,766,808.30
------------	--------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	HANG SENG CHINA ENT IND ETF	股票型	ETF	Hang Seng Investment Management Ltd	4,058,853.92	11.48
2	XTRACKERS HARVEST CSI 300 CH	股票型	ETF	DBX Advisors LLC	2,097,669.00	5.93
3	ISHARES BARCLAYS USD AHYB	债券型	ETF	BlackRock Singapore Ltd	1,968,686.75	5.57
4	KRANESHARES CSI CHINA INTERN	股票型	ETF	Krane Funds Advisors LLC	1,085,073.30	3.07
5	TEUCRIUM SOYBEAN FUND	商品型	ETF	Teucrium Trading LLC	709,827.50	2.01
6	ISHARES CHINA LARGE-CAP	股票型	ETF	BlackRock Fund Advisors	705,423.09	1.99

	ETF					
7	GLOBAL X LITHIUM & BATTERY T	股票型	ETF	Global X Management Co LLC	678,327.62	1.92
8	FIRST TRUST INDXX NEXTG ETF	股票型	ETF	First Trust Advisors LP	575,320.92	1.63
9	CSOP SZSE CHINEXT ETF-HKD	股票型	ETF	CSOP Asset Management Ltd	202,494.50	0.57

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,279,750.78
3	应收股利	6,186.38
4	应收利息	508.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,286,445.98

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
鹏华全球中短债债券(QDII)A类	1,186	105,259.29	112,021,010.59	89.73	12,816,507.89	10.27
鹏华全球中短债债券(QDII)C类	315	224,725.89	67,078,635.84	94.76	3,710,019.09	5.24
合计	1,501	130,330.56	179,099,646.43	91.55	16,526,526.98	8.45

注：无。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华全球中短债债券(QDII)A类	121,243.02	0.0971
	鹏华全球中短债债券(QDII)C类	1,148,933.12	1.6230
	合计	1,270,176.14	0.6493

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏华全球中短债债券(QDII)A类	0~10
	鹏华全球中短债债券(QDII)C类	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华全球中短债债券(QDII)A类	0~10

	鹏华全球中短债债券 (QDII)C 类	—
	合计	0~10

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
758	46,655.05	29,861,172.25	84.44	5,503,356.91	15.56

注：无。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

§ 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	鹏华全球中短债债券(QDII)A 类	鹏华全球中短债债券(QDII)C 类
基金合同生效日 (2020 年 1 月 8 日) 基金份额总额	35,364,529.16	—
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	96,858,380.21	72,103,475.19
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	7,385,390.89	1,314,820.26
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分	—	—

变动份额（份额减少以“-”填列）		
本报告期期末基金份额总额	124,837,518.48	70,788,654.93

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2010年10月12日） 基金份额总额	534,464,662.52
本报告期期初基金份额总额	35,733,125.54
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	739,765.70
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	371,169.32
本报告期期末基金份额总额	35,364,529.16

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金由原鹏华环球发现证券投资基金转型而来，新合同于2020年1月8日生效。新的投资策略主要以全球市场的中短期债券为主要投资标的，力争获取高于业绩比较基准的投资收益

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	16,390,323.12	30.89%	14,936.57	21.64%	-
DAIWA	-	15,796,629.56	29.77%	34,841.54	50.48%	-
国信证券	2	13,205,825.82	24.89%	13,020.08	18.86%	-
申万宏源	1	7,667,920.51	14.45%	6,220.96	9.01%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
BARCLAY	-	-	-	-	-	-
CEB	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-
GS	-	-	-	-	-	-
gtja	-	-	-	-	-	-

JP Morgan	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch International	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
SCLWY	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-
华泰金控	-	-	-	-	-	-
兴证国际	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
招商证券(香港)	-	-	-	-	-	-
申银万国(香港)	-	-	-	-	-	-
元大证券(香港)	-	-	-	-	-	-
国元证券(香港)	-	-	-	-	-	-
BMO	-	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性、及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交总 额的比例	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
方正证券	832,327.13	0.45%	-	-	-	-	-	-
DAIWA	-	-	-	-	-	-	15,041,387.83	100.00%
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAY	13,919,775.45	7.57%	-	-	-	-	-	-
CEB	4,949,055.30	2.69%	-	-	-	-	-	-
CITI	32,092,501.97	17.46%	-	-	-	-	-	-
GS	23,897,677.85	13.00%	-	-	-	-	-	-
gtja	31,075,956.70	16.90%	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	13,606,327.98	7.40%	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch International	16,585,805.25	9.02%	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	23,427,354.41	12.74%	-	-	-	-	-	-
SLOWY	10,465,343.73	5.69%	-	-	-	-	-	-
UBS	1,387,891.70	0.75%	-	-	-	-	-	-
海通国际	5,631,309.63	3.06%	-	-	-	-	-	-
华泰金控	3,216,568.52	1.75%	-	-	-	-	-	-
兴证国际	2,757,305.69	1.50%	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
元大证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券(香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO	-	-	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成	佣金	占当期佣	

			交总额的比例		金 总量的比 例	
DAIWA	-	2,753,838.59	100.00%	4,129.10	100.00%	-
BARCLAY	-	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

(香港)						
申银万国 (香港)	-	-	-	-	-	-
元大证券 (香港)	-	-	-	-	-	-
国元证券 (香港)	-	-	-	-	-	-
国泰君安 (香港)	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-
BMO	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性、及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专

用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券 成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
DAIWA	-	-	-	-	-	-	1,845,321.99	100.00%
BARCLAY	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券 (香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-

(香港)								
元大证券 (香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券 (香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 (香港)	-	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）基金合同及招募说明书提示性公告	《证券时报》	2020 年 01 月 08 日
2	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）恢复大额申购、定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2020 年 06 月 04 日
3	鹏华环球发现证券投资基金基金份额折算和变更登记结果暨鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）基金合同生效的公告	《证券时报》	2020 年 01 月 09 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020 年 01 月 16 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 01 月 17 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 17 日
8	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 20 日
9	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金	《证券时报》	2020 年 01 月 20 日

	2019 年第 4 季度报告提示性公告		
10	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 20 日
11	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下 基金 2020 年春节假期清算交收安排 及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 02 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下 基金 2020 年春节假期清算交收安排 及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券时报》	2020 年 02 月 03 日
13	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下 基金 2020 年春节假期清算交收安排 及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 03 日
14	鹏华基金管理有限公司关于使用不低 于 5000 万元自有资金购买本公司旗 下偏股型公募基金的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 05 日
15	鹏华基金管理有限公司关于使用不低 于 5000 万元自有资金购买本公司旗 下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 05 日
16	鹏华基金管理有限公司关于使用不低 于 5000 万元自有资金购买本公司旗 下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 05 日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏 汇林保大基金销售有限公司为旗下部 分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 13 日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏 汇林保大基金销售有限公司为旗下部 分基金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 13 日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加北京 汇成基金销售有限公司为旗下部分基 金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 17 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在直销渠道开展申购费率优惠活 动的公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 04 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在直销渠道开展申购费率优惠活 动的公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 04 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金在直销渠道开展申购费率优惠活 动的公告	《证券时报》	2020 年 03 月 04 日
23	鹏华基金管理有限公司关于增加上海 基煜基金销售有限公司为旗下部分基 金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 03 月 19 日
24	鹏华基金管理有限公司关于增加上海 基煜基金销售有限公司为旗下部分基	《中国证券报》	2020 年 03 月 19 日

	金销售机构的公告		
25	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 19 日
26	鹏华基金管理有限公司关于鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)暂停大额申购、定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2020 年 03 月 26 日
27	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日
28	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券时报》	2020 年 03 月 28 日
29	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券日报》	2020 年 03 月 28 日
30	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
31	鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)2020 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回和定投业务的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 08 日
32	鹏华基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 09 日
33	鹏华基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 09 日
34	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 05 日
35	鹏华基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 13 日
36	鹏华基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 13 日
37	鹏华基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 13 日
38	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 18 日
39	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金	《证券时报》	2020 年 04 月 18 日

	2019年年度报告提示性公告		
40	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年04月18日
41	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019年年度报告提示性公告	《上海证券报》	2020年04月18日
42	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020年第1季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020年04月22日
43	鹏华基金管理有限公司关于增加上海 万得基金销售有限公司为旗下部分基 金销售机构的公告	《证券时报》	2020年04月22日
44	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020年第1季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020年04月22日
45	鹏华基金管理有限公司关于增加上海 万得基金销售有限公司为旗下部分基 金销售机构的公告	《证券日报》	2020年04月22日
46	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020年第1季度报告提示性公告	《证券日报》	2020年04月22日
47	鹏华基金管理有限公司关于增加上海 万得基金销售有限公司为旗下部分基 金销售机构的公告	《上海证券报》	2020年04月22日
48	鹏华基金管理有限公司关于增加上海 万得基金销售有限公司为旗下部分基 金销售机构的公告	《中国证券报》	2020年04月22日
49	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020年第1季度报告提示性公告	《证券时报》	2020年04月22日
50	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下 基金在中信证券华南股份有限公司 (原广州证券股份有限公司)申购费 率优惠活动的公告	《证券时报》	2020年04月28日
51	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下 基金在中信证券华南股份有限公司 (原广州证券股份有限公司)申购费 率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020年04月28日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安证券股份有限公司申购 (含定期定额申购)费率优惠活动的 公告	《证券时报》	2020年05月06日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安证券股份有限公司申购 (含定期定额申购)费率优惠活动的 公告	《证券日报》	2020年05月06日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安证券股份有限公司申购 (含定期定额申购)费率优惠活动的	《上海证券报》	2020年05月06日

	公告		
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 06 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 18 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 05 月 18 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 18 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 18 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 05 月 23 日
61	鹏华全球中短债债券型证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2020 年 01 月 09 日

注：无。

10.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 04 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 04 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《证券日报》	2020 年 01 月 04 日

	基金参与中国农业银行股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告		
--	--	--	--

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200109~20200219	9,527,430.22	101,056.02	—	9,628,486.24	5.36
	2	20200219~20200219	—	15,358,888.94	—	15,358,888.94	8.56
	3	20200109~20200326	20,020,333.33	212,352.67	—	20,232,686.00	11.27
	4	20200325~20200402	—	21,455,696.20	—	21,455,696.20	11.95
个人	—	—	—	—	—	—	—
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(一)《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)基金合同》；

(二)《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)托管协议》；

(三)《鹏华全球中短债债券型证券投资基金(QDII)2020 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司。

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日